

大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)
(原景福证券投资基金转型)
2014年年度报告摘要

2014年12月31日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2015年3月28日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）由景福证券投资基金转型而来。基金转型经景福证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 2014 年 12 月 26 日起，由《景福证券投资基金基金合同》修订而成的《大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，原《景福证券投资基金基金合同》同日起失效。

大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）是股票基金，预期风险收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金，属于预期风险收益水平较高的品种。本基金投资于证券市场，基金净值会因证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立、谨慎决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的操作或技术风险、本基金的特有风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

自 2014 年 12 月 25 日景福证券投资基金终止上市起，原景福证券投资基金名称变更为大成

产业升级股票型证券投资基金（LOF）。原景福证券投资基金本报告期自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 25 日止，大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）本报告期自 2014 年 12 月 26 日（基金合同生效日）起至 2014 年 12 月 31 日止。

§ 2 1.2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	大成景福封闭
场内简称	基金景福
基金主代码	184701
交易代码	184701
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999 年 12 月 30 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00 份
基金合同存续期（若有）	15 年
基金份额上市的证券交易所（若有）	深圳证券交易所
上市日期（若有）	2000-01-10

注：经深交所《终止上市通知书》（深证上[2014]477 号）同意，基金景福于 2014 年 12 月 25 日进行终止上市权益登记，并于 2014 年 12 月 26 日终止上市。

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	大成产业升级股票(LOF)
场内简称	大成产业
基金主代码	160919
交易代码	160919
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2014 年 12 月 26 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00 份
基金合同存续期（若有）	不定期
基金份额上市的证券交易所（若有）	深圳证券交易所
上市日期（若有）	2015-01-09

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	通过指数化投资和积极投资的有机结合，实现投资风险和收益的优化平衡，力求使基金取得超过市场的投资收益，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的指数投资部分采用分层抽样法，选择代表上证 A 股市场整体特征的股票构建投资组合；积极投资部分则投资于高成长行业或价值低估行业的股票。整体投资力求超越基准指数表现。
业绩比较基准（若有）	无

风险收益特征（若有）	无
------------	---

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金重点投资于与产业升级主题相关的行业和企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准（若有）	沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征（若有）	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	林葛
	联系电话	0755-83183388	010-66060069
	电子邮箱	dupeng@dcfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008885558	95599
传真		0755-83199588	010-68121816

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层大成基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 中国农业银行股份有限公司托管业务部

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2014年1月1日-2014年12月31日		2013年	2012年
	转型前	转型后		
本期已实现收益	137,838,218.75	15,562,584.50	-3,818,739.51	-415,582,016.40
本期利润	330,797,461.42	-21,389,799.17	25,135,068.81	105,679,114.42
加权平均基金份额本期利润	0.1103	-0.0071	0.0084	0.0352
本期基金份额净值增长率	11.67%	-0.71%	0.90%	3.91%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末(2014年 12月25日)	报告期末(2014年12月 31日)	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0006	0.0058	-0.0557	-0.0641
期末基金资产净值	3,163,582,289.74	3,142,192,490.57	2,832,784,828.32	2,807,649,759.51
期末基金份额净值	1.0545	1.047	0.9443	0.9359

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

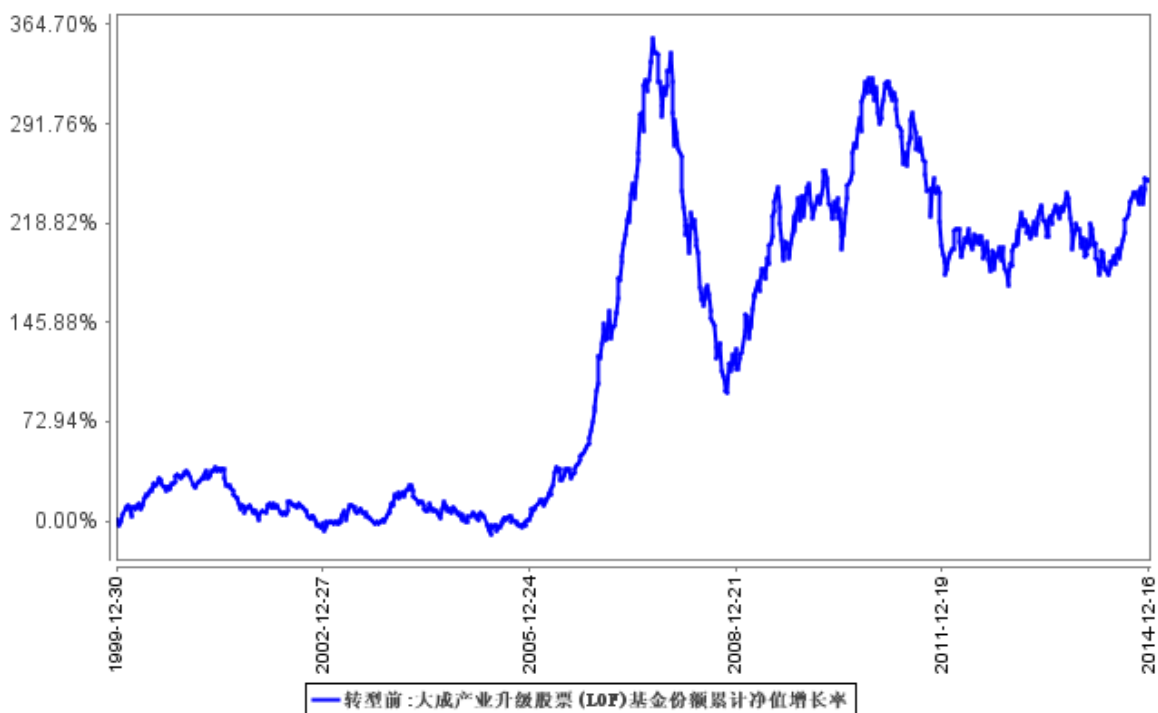
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

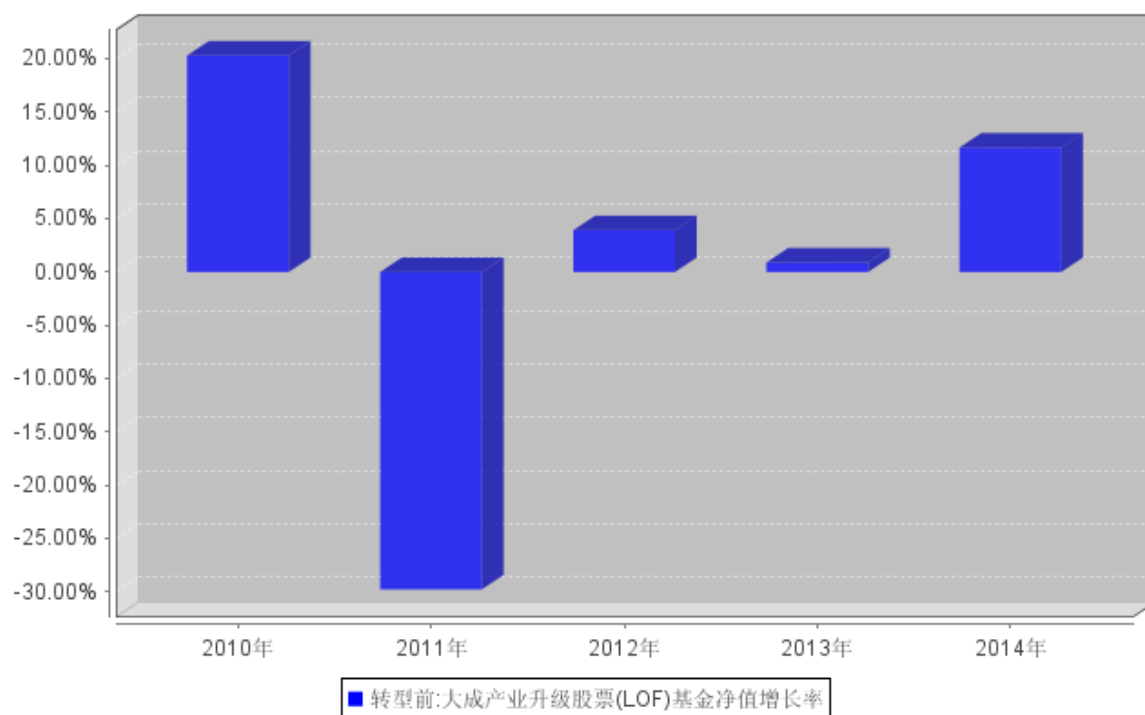
转型前						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.07%	2.05%	-	-	-	-
过去六个月	14.78%	1.68%	-	-	-	-
过去一年	11.90%	2.07%	-	-	-	-
过去三年	15.41%	2.17%	-	-	-	-
过去五年	1.40%	2.36%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	240.90%	2.63%	-	-	-	-

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率历史走势图



注：按基金合同规定，本基金应在合同生效后三个月内达到规定的投资比例。截至报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同第七条之(七)投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

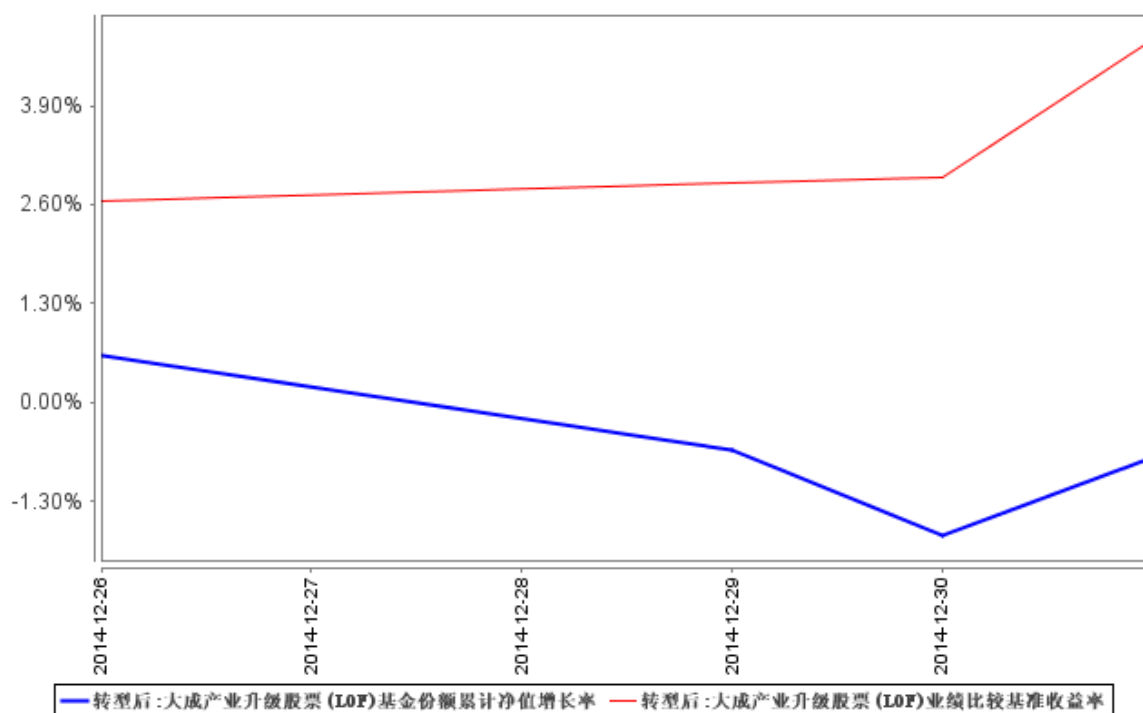


3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

转型后						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	-0.71%	1.18%	4.77%	1.25%	-5.48%	-0.07%

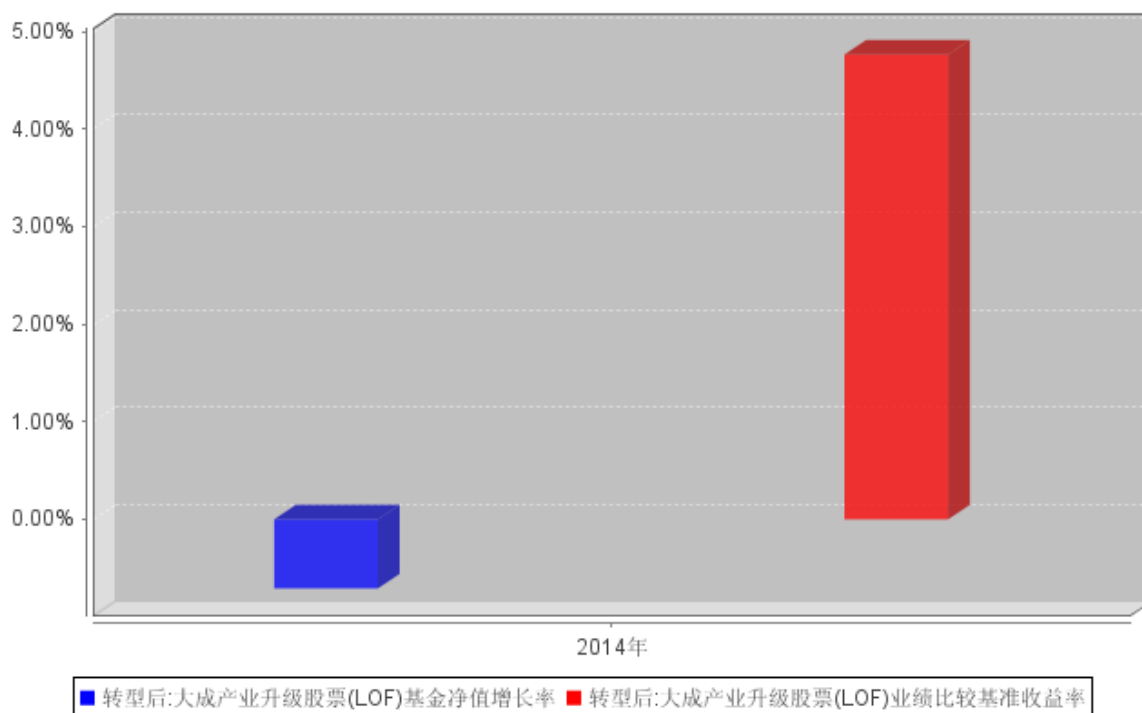
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金于2014年12月25日转型，截至报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末，本基金仍在建仓期。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

本基金过去三年未有收益分配事项。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

本基金自 2014 年 12 月 26 日(基金合同生效日)以来未有收益分配事项。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由四家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(48%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)、广东证券股份有限公司(2%)。截至2014年12月31日，本基金管理人共管理4只ETF及1只ETF联接基金：大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500深市交易型开放式指数证券投资基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金，2只QDII基金：大成标普500等权重指数证券投资基金、大成纳

斯达克 100 指数证券投资基金及 40 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金

(LOF)、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业股票型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金(LOF)、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金和大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王文祥先生	本基金基金经理	2014 年 7 月 26 日	2014 年 12 月 25 日	7 年	清华大学工学硕士。2007 年 7 月至 2014 年 3 月任职于长城基金管理有限公司，历任研究部行业研究员，基金经理助理及长城双动力股票型证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金基金经理。2014 年 3 月加入大成基金管理有限公司，现任研究部总监。2014 年 7 月 26 日至 2014 年 12 月 25 日任景福证券投资基金基金经理。2014 年 12 月 26 日起任大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
邓涛先生	本基金基金经理	2011 年 7 月 29 日	2014 年 10 月 27 日	6 年	经济学硕士，2008 年 6 月至 2009 年 2 月就职于长江证券研究部，2009 年

	理助理				2月加入大成基金管理有限公司，历任研究部总监助理，2011年7月29日起担任景福证券投资基金和大成内需增长股票型证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。国籍：中国
李林益先生	本基金基金经理助理	2014年10月28日	2014年12月25日	4年	工学硕士。2011年6月加入大成基金管理有限公司。2014年10月28日起担任景福证券投资基金基金经理助理（该基金于2014年12月26日转型成为大成产业升级股票型证券投资基金（LOF））。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王文祥先生	本基金基金经理	2014年12月26日	-	7年	清华大学工学硕士。2007年7月至2014年3月任职于长城基金管理有限公司，历任研究部行业研究员，基金经理助理及长城双动力股票型证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金基金经理。2014年3月加入大成基金管理有限公司，现任研究部总监。2014年7月26日至2014年12月25日任景福证券投资基金基金经理。2014年12月26日起任大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
李林益先生	本基金基金经理助理	2014年12月26日	-	4年	工学硕士。2011年6月加入大成基金管理有限公司。2014年10月28日起担任景福证券投资基金基金经理助理（该基金于2014年12月26日转型成为大成产业升级股票型证券投资基金（LOF））。具有基金从业资格。国籍：中国

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《景福证券投资基金基金合同》、《大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，基金管理人制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》及《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；股票同向交易溢价率较大主要来源于市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 23 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交

易量超过该股当日成交量 5%的仅有 5 笔，原因为投资策略需要；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金配置了精选的低估值确定性成长的家电、汽车、部分地产产业链等公司，同时保留了受益于高铁建设产业链的进口替代的成长类公司，还布局了可再生资源板块和环境监测行业。此外，本基金还积极配置了有着海量税控数据的转型公司、互联网金融和征信公司。

由于对降息降准时间节点预期不足，本基金四季度仍配置了较多成长类资产，未能及时抓住年末的蓝筹股行情，也使得基金净值受到了一定回调，甚为可惜。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额资产净值为 1.047 元。本报告期内，转型前基金份额净值增长率为 11.67%；转型后基金份额净值增长率为-0.71%，同期业绩比较基准收益率为 4.77%，低于业绩比较基准的表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前中国经济仍处于转型调结构的失速区间，政府进行微刺激、降息、扩大铁路等基建投资，来缓解经济总需求不足、市场资金利率高企、固定资产投资下滑等经济中长期问题。究其缘由，是经济需要保持一定增速为企业转型提供缓冲时间，防止经济硬着陆对企业的破坏式冲击。传统周期性行业产能过剩严重，另一边是新兴产业体量尚小，市场化改革去产能和市场化培育新兴产业的都需要较长时间。即使今年经济增长目标达到了，仍是“稳住”的经济增长，而非经济内生增速。

经过 2014 年年底大幅修复，2015 年市场仍可期望走出不一样的精彩。对于 2015 年，我们认为新经济攻城略地、传统产业拥抱互联网、环保和可再生资源利用、高端装备及进口替代、军工和国家大安全持续强化等，都将持续影响市场。虽然指数经过了大幅反弹，但 A 股估值水平仍处于低位，因此超预期的下跌空间不大。本基金仍会坚守具有核心竞争力的价值型行业作为本基金核心持仓，同时选择受益于经济转型并具备持续成长能力的行业作为进攻组合，中长线布局，保持耐心，控制仓位，规避风险，力争为持有人作出更好业绩回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估

值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部、委托投资部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括两名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益部、风险管理部和委托投资部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理及投资经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金

法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一大成基金管理有限公司 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告(转型前)

本基金 2014 年年度财务报表已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§ 6 审计报告(转型后)

本基金 2014 年年度财务报表已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解本基金审计报告详细内容,应阅读年度报告正文。

§ 7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：景福证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 25 日

单位：人民币元

资产	报告期初至转型前	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	270,160,405.29	51,825,837.75
结算备付金	5,807,739.96	2,370,946.63
存出保证金	819,693.61	811,823.79
交易性金融资产	2,828,709,354.61	2,780,618,096.59
其中：股票投资	2,182,555,798.41	2,186,857,438.99
基金投资	-	-
债券投资	646,153,556.20	593,760,657.60
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	43,287,354.59	5,023,944.71
应收利息	24,888,048.61	12,457,813.36
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,173,672,596.67	2,853,108,462.83
负债和所有者权益	报告期初至转型前	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	13,617,352.59
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,768,436.16	3,052,444.30
应付托管费	553,687.22	610,488.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,331,906.44	1,801,640.36
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,436,277.11	1,241,708.38
负债合计	10,090,306.93	20,323,634.51
所有者权益：		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00

未分配利润	163,582,289.74	-167,215,171.68
所有者权益合计	3,163,582,289.74	2,832,784,828.32
负债和所有者权益总计	3,173,672,596.67	2,853,108,462.83

注：1、报告截止日 2014 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 1.0545 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

2、本期财务报表的实际编制期间为 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 25 日(基金合同失效前日)止期间。

7.2 利润表

会计主体：景福证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 25 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 25 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入	393,507,164.15	83,250,182.21
1. 利息收入	27,077,050.84	23,607,738.38
其中：存款利息收入	620,671.26	526,814.50
债券利息收入	26,362,397.66	23,080,923.88
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	93,981.92	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	173,470,870.64	30,607,839.70
其中：股票投资收益	152,260,764.18	6,107,348.27
基金投资收益	-	-
债券投资收益	280,232.34	-6,455,634.68
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	20,929,874.12	30,956,126.11
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	192,959,242.67	28,953,808.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	80,795.81
减：二、费用	62,709,702.73	58,115,113.40
1. 管理人报酬	35,659,552.57	37,083,422.58
2. 托管费	7,131,910.52	7,416,684.43
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	19,326,510.68	13,091,269.91

5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	591,728.96	523,736.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	330,797,461.42	25,135,068.81
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	330,797,461.42	25,135,068.81

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景福证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 25 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 25 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	-167,215,171.68	2,832,784,828.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	330,797,461.42	330,797,461.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	163,582,289.74	3,163,582,289.74
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	-192,350,240.49	2,807,649,759.51
二、本期经营活动产生的	-	25,135,068.81	25,135,068.81

基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	-167,215,171.68	2,832,784,828.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 罗登攀 肖剑 范瑛
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

除上述会计政策变更事项，本报告期所采用的其他会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金发起人、基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金发起人、基金管理人的股东
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东

广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金发起人、基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注：1、中国证监会于2005年11月6日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月 25日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
光大证券	1,147,564,167.28	9.04%	1,590,816,537.40	18.40%

7.4.3.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月25日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
光大证券	1,044,737.64	9.20%	382,720.20	7.18%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
光大证券	1,448,274.96	18.64%	16,372.34	0.91%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月25日	2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	35,659,552.57	37,083,422.58
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	-	-

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.25% / 当年天数。若由于卖出回购证券和现金分红以外原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的 20%，超过部分不计提管理人报酬。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月25日	2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,131,910.52	7,416,684.43

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2014年1月1日至2014年12月25日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	60,812,416.44	-	-	-	-	-

7.4.3.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月25日	2013年1月1日至2013年12月31日
期初持有的基金份额	7,500,000.00	7,500,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	7,500,000.00	7,500,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.25%	0.25%

7.4.3.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2014年12月25日		2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
光大证券	3,750,300.00	0.13%	3,750,300.00	0.13%
广东证券	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%

7.4.3.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年12月25日		2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	270,160,405.29	542,574.29	51,825,837.75	452,368.86

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.3.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.3.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.4 利润分配情况

7.4.4.1 利润分配情况——非货币市场基金

本报告期内本基金无利润分配事项。

7.4.5 期末（2014 年 12 月 25 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000008	宝利来	2014 年 12 月 18 日	发行 股份 购买 资产	24.18	2014 年 12 月 29 日	26.60	1,947,360	47,752,552.41	47,087,164.80	-
002009	天奇股份	2014 年 10 月 20 日	重大 资产 重组	18.12	2015 年 1 月 28 日	17.93	2,642,153	41,058,573.44	47,875,812.36	-
002050	三花股份	2014 年 10 月 27 日	重大 资产 重组	15.38	2015 年 1 月 27 日	14.93	9,286,311	96,816,786.36	142,823,463.18	-
300011	鼎汉技术	2014 年 11 月 24 日	重大 资产 重组	20.10	2015 年 2 月 3 日	18.98	6,356,885	80,855,515.78	127,773,388.50	-
300159	新研股份	2014 年 12 月 1 日	重大 资产 重组	16.51	2015 年 3 月 18 日	18.16	200,000	2,930,171.55	3,302,000.00	-

注：本基金截至 2014 年 12 月 25 日（基金合同失效前日）止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§ 7 年度财务报表(转型后)

7.1 资产负债表(转型后)

会计主体：大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	转型后至报告期末
资产：	
银行存款	499,544,180.48
结算备付金	5,807,739.96
存出保证金	819,693.61
交易性金融资产	2,596,764,595.68
其中：股票投资	1,949,891,161.08
基金投资	-
债券投资	646,873,434.60
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	25,072,615.47
应收利息	25,438,800.50
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	3,153,447,625.70
负债和所有者权益	转型后至报告期末
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	3,547,581.72

应付托管费	683,544.81
应付销售服务费	-
应付交易费用	5,580,495.22
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	1,443,513.38
负债合计	11,255,135.13
所有者权益：	
实收基金	3,000,000,000.00
未分配利润	142,192,490.57
所有者权益合计	3,142,192,490.57
负债和所有者权益总计	3,153,447,625.70

注：1. 报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.047 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

2. 本期财务报表的实际编制期间为 2014 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2014 年 12 月 26 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2014 年 12 月 26 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	-19,949,744.70
1. 利息收入	550,751.89
其中：存款利息收入	39,976.32
债券利息收入	510,775.57
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	16,451,887.08
其中：股票投资收益	16,455,087.38
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-3,200.30

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-36,952,383.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、费用	1,440,054.47
1. 管理人报酬	779,145.56
2. 托管费	129,857.59
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	523,765.05
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	7,286.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-21,389,799.17
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-21,389,799.17

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2014年12月26日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年12月26日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	163,582,289.74	3,163,582,289.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-21,389,799.17	-21,389,799.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 （净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	142,192,490.57	3,142,192,490.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 罗登攀	_____ 肖剑	_____ 范瑛
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

除上述会计政策变更事项，本报告期所采用的其他会计政策、会计估计、税项与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司(“大成基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东证券股份有限公司(“广东证券”)	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司(“大成国际”)	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司(“大成创新资本”)	基金管理人的合营企业

注：1、中国证监会于 2005 年 11 月 6 日作出对广东证券取消业务许可并责令关闭的行政处罚。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期间的关联方交易

本基金本报告期未有通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.3.1 关联方报酬

7.4.3.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 12 月 26 日至 2014 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	779,145.56
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.3.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 12 月 26 日至 2014 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	129,857.59

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.3.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.3.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2014 年 12 月 26 日至 2014 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2014 年 12 月 26 日）持有的基金份额	7,500,000.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分增加的份额	-
期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	7,500,000.00

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.25%
-----------------------	-------

7.4.3.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
光大证券	3,750,300.00	0.13%
广东证券	3,750,000.00	0.13%

7.4.3.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年12月26日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	499,544,180.48	38,186.88

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.3.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.3.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.4 利润分配情况

7.4.4.1 利润分配情况——非货币市场基金

本报告期内本基金无利润分配事项。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限股票。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌	期末 估值单	复牌日期	复牌 开盘单价	数量（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
------	------	------	----	-----------	------	------------	-------	------------	------------	----

			原因	价						
002009	天奇股份	2014年10月20日	重大资产重组	17.87	2015年1月28日	17.93	2,642,153	41,058,573.44	47,215,274.11	-
002050	三花股份	2014年10月27日	重大事项	15.18	2015年1月27日	14.93	9,286,311	96,816,786.36	140,966,200.98	-
300011	鼎汉技术	2014年11月24日	重大资产重组	20.25	2015年2月3日	18.98	6,356,885	80,855,515.78	128,726,921.25	-
300159	新研股份	2014年12月1日	重大资产重组	16.51	2015年3月18日	18.16	200,000	2,930,171.55	3,302,000.00	-

注：本基金截至本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§8 投资组合报告(转型前)

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的
----	----	----	---------

			比例 (%)
1	权益投资	2,182,555,798.41	68.77
	其中：股票	2,182,555,798.41	68.77
2	固定收益投资	646,153,556.20	20.36
	其中：债券	646,153,556.20	20.36
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	275,968,145.25	8.70
7	其他资产	68,995,096.81	2.17
8	合计	3,173,672,596.67	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,627,174,523.47	51.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,077,888.00	1.42
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,361,000.00	0.07
H	住宿和餐饮业	47,087,164.80	1.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,999,743.06	3.41
J	金融业	320,809,320.51	10.14
K	房地产业	32,046,158.57	1.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,182,555,798.41	68.99

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	11,300,028	163,737,405.72	5.18
2	000625	长安汽车	8,715,849	144,944,568.87	4.58
3	002050	三花股份	9,286,311	142,823,463.18	4.51
4	300011	鼎汉技术	6,356,885	127,773,388.50	4.04
5	600570	恒生电子	1,649,860	97,391,235.80	3.08
6	002303	美盈森	6,001,596	89,063,684.64	2.82
7	002547	春兴精工	5,421,698	87,885,724.58	2.78
8	001696	宗申动力	9,549,889	84,421,018.76	2.67
9	002584	西陇化工	4,471,690	81,384,758.00	2.57
10	600016	民生银行	7,520,043	80,765,261.82	2.55

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(<http://www.dcfund.com.cn>)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	210,070,892.52	7.42%
2	000625	长安汽车	151,858,535.30	5.36%
3	002547	春兴精工	146,196,703.28	5.16%
4	600277	亿利能源	140,131,989.38	4.95%
5	002008	大族激光	127,586,000.79	4.50%
6	001696	宗申动力	116,469,415.29	4.11%
7	002584	西陇化工	106,933,548.79	3.77%

8	601222	林洋电子	103,741,670.55	3.66%
9	002384	东山精密	101,875,624.62	3.60%
10	300303	聚飞光电	101,096,889.49	3.57%
11	002050	三花股份	99,989,975.83	3.53%
12	600742	一汽富维	96,804,456.08	3.42%
13	600570	恒生电子	96,543,356.41	3.41%
14	600741	华域汽车	96,314,308.05	3.40%
15	002665	首航节能	96,102,468.44	3.39%
16	600850	华东电脑	92,167,551.64	3.25%
17	000958	东方能源	87,961,528.51	3.11%
18	600270	外运发展	87,159,253.74	3.08%
19	600016	民生银行	86,911,997.19	3.07%
20	000681	视觉中国	85,651,091.77	3.02%
21	002303	美盈森	82,933,996.87	2.93%
22	300011	鼎汉技术	80,855,515.78	2.85%
23	300225	金力泰	78,469,840.67	2.77%
24	300088	长信科技	78,379,469.61	2.77%
25	300207	欣旺达	77,438,049.32	2.73%
26	600309	万华化学	77,432,072.62	2.73%
27	601058	赛轮金宇	76,883,093.04	2.71%
28	600660	福耀玻璃	76,704,960.06	2.71%
29	002572	索菲亚	75,841,651.76	2.68%
30	601318	中国平安	70,853,459.42	2.50%
31	600208	新湖中宝	67,299,893.94	2.38%
32	002325	洪涛股份	67,035,726.10	2.37%
33	002650	加加食品	64,277,117.68	2.27%
34	002341	新纶科技	64,139,135.28	2.26%
35	002340	格林美	60,833,374.60	2.15%
36	002711	欧浦钢网	60,728,698.81	2.14%
37	000963	华东医药	60,337,633.49	2.13%
38	002454	松芝股份	59,988,320.28	2.12%
39	600183	生益科技	59,346,447.55	2.09%
40	600718	东软集团	56,680,066.18	2.00%

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002008	大族激光	258,813,657.88	9.14%
2	600887	伊利股份	191,060,348.73	6.74%
3	000063	中兴通讯	176,226,269.49	6.22%
4	601222	林洋电子	169,999,601.96	6.00%
5	600859	王府井	169,408,879.58	5.98%
6	600518	康美药业	160,625,015.72	5.67%
7	600742	一汽富维	140,695,717.73	4.97%
8	002665	首航节能	136,496,162.48	4.82%
9	600270	外运发展	133,592,494.13	4.72%
10	300088	长信科技	126,399,595.48	4.46%
11	600660	福耀玻璃	122,187,891.29	4.31%
12	002081	金螳螂	118,216,213.67	4.17%
13	002475	立讯精密	111,349,686.97	3.93%
14	002325	洪涛股份	107,010,432.13	3.78%
15	600850	华东电脑	105,921,648.94	3.74%
16	600016	民生银行	100,521,649.92	3.55%
17	600729	重庆百货	93,479,768.81	3.30%
18	000681	视觉中国	83,620,537.44	2.95%
19	000958	东方能源	77,693,761.90	2.74%
20	002454	松芝股份	71,940,708.81	2.54%
21	300207	欣旺达	69,456,301.78	2.45%
22	600277	亿利能源	67,733,912.41	2.39%
23	300351	永贵电器	66,250,306.46	2.34%
24	000963	华东医药	65,667,778.30	2.32%
25	601238	广汽集团	63,793,015.43	2.25%
26	002650	加加食品	62,631,314.82	2.21%
27	600309	万华化学	62,342,301.09	2.20%
28	600990	四创电子	61,314,140.82	2.16%
29	600252	中恒集团	59,331,807.80	2.09%
30	300139	福星晓程	59,110,065.30	2.09%
31	600741	华域汽车	58,166,791.54	2.05%
32	600183	生益科技	57,429,231.66	2.03%
33	000001	平安银行	57,095,102.47	2.02%
34	002230	科大讯飞	56,649,547.08	2.00%

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,177,546,907.51
卖出股票收入（成交）总额	6,515,055,383.02

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	32,133,132.20	1.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	609,417,716.00	19.26
	其中：政策性金融债	609,417,716.00	19.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,602,708.00	0.15
8	其他	-	-
9	合计	646,153,556.20	20.42

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140204	14 国开 04	1,800,000	180,018,000.00	5.69
2	018001	国开 1301	1,161,200	118,941,716.00	3.76
3	140207	14 国开 07	1,100,000	110,132,000.00	3.48
4	140430	14 农发 30	700,000	70,077,000.00	2.22
5	140212	14 国开 12	600,000	60,060,000.00	1.90

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	819,693.61
2	应收证券清算款	43,287,354.59
3	应收股利	-
4	应收利息	24,888,048.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,995,096.81

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110023	民生转债	4,602,708.00	0.15

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002050	三花股份	142,823,463.18	4.51	重大事项
2	300011	鼎汉技术	127,773,388.50	4.04	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 投资组合报告(转型后)

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,949,891,161.08	61.83
	其中：股票	1,949,891,161.08	61.83
2	固定收益投资	646,873,434.60	20.51
	其中：债券	646,873,434.60	20.51
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	505,351,920.44	16.03
7	其他资产	51,331,109.58	1.63
8	合计	3,153,447,625.70	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,452,342,198.24	46.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,231,317.78	1.98
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,277,000.00	0.07
H	住宿和餐饮业	43,017,182.40	1.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,471,580.56	2.91
J	金融业	298,550,974.42	9.50
K	房地产业	907.68	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,949,891,161.08	62.06

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细(转型后)

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002050	三花股份	9,286,311	140,966,200.98	4.49
2	601166	兴业银行	8,500,028	140,250,462.00	4.46
3	300011	鼎汉技术	6,356,885	128,726,921.25	4.10
4	000625	长安汽车	7,715,922	126,772,598.46	4.03
5	002547	春兴精工	5,721,698	93,950,281.16	2.99
6	600570	恒生电子	1,649,860	90,346,333.60	2.88

7	600016	民生银行	7,520,043	81,818,067.84	2.60
8	002303	美盈森	5,801,596	77,857,418.32	2.48
9	002572	索菲亚	3,578,330	76,576,262.00	2.44
10	601318	中国平安	1,003,300	74,956,543.00	2.39

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于大成基金管理有限公司网站(<http://www.dcfund.com.cn>)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000791	甘肃电投	17,144,295.91	0.55
2	600271	航天信息	6,083,078.00	0.19
3	002547	春兴精工	4,838,090.57	0.15
4	000619	海螺型材	1,553,200.00	0.05
5	600036	招商银行	1,500,408.00	0.05
6	300103	达刚路机	506,960.00	0.02
7	002651	利君股份	497,800.00	0.02
8	002366	丹甫股份	304,015.00	0.01

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	44,913,585.00	1.43
2	600208	新湖中宝	35,956,574.40	1.14
3	601058	赛轮金宇	35,940,191.75	1.14
4	002481	双塔食品	31,244,360.92	0.99
5	600309	万华化学	21,499,578.46	0.68
6	000625	长安汽车	16,620,672.58	0.53
7	601318	中国平安	14,402,893.76	0.46
8	300066	三川股份	10,361,337.67	0.33
9	300059	东方财富	9,448,669.89	0.30
10	001696	宗申动力	7,794,077.71	0.25

11	002384	东山精密	5,418,179.55	0.17
12	002584	西陇化工	4,917,331.84	0.16
13	000425	徐工机械	2,684,204.63	0.09
14	002303	美盈森	2,673,651.96	0.09

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	32,427,847.48
卖出股票收入（成交）总额	243,875,310.12

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	32,108,600.60	1.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	609,870,076.00	19.41
	其中：政策性金融债	609,870,076.00	19.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,894,758.00	0.16
8	其他	-	-
9	合计	646,873,434.60	20.59

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140204	14国开04	1,800,000	180,036,000.00	5.73
2	018001	国开1301	1,161,200	119,290,076.00	3.80
3	140207	14国开07	1,100,000	110,165,000.00	3.51
4	140430	14农发30	700,000	70,119,000.00	2.23
5	140212	14国开12	600,000	60,078,000.00	1.91

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	819,693.61
2	应收证券清算款	25,072,615.47
3	应收股利	-

4	应收利息	25,438,800.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,331,109.58

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110023	民生转债	4,894,758.00	0.16

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002050	三花股份	140,966,200.98	4.49	重大事项
2	300011	鼎汉技术	128,726,921.25	4.10	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息(转型前)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
23,709	126,534.23	2,142,842,991.00	71.43%	857,157,009.00	28.57%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
----	-------	----------	----------

1	中国人寿保险（集团）公司	496,754,277.00	16.56%
2	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	247,831,402.00	8.26%
3	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L-FH002 深	203,567,073.00	6.79%
4	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品—013C-CT001 深	188,241,873.00	6.27%
5	中国人寿保险股份有限公司	173,195,142.00	5.77%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	126,977,498.00	4.23%
7	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金—012G-ZY001 深	99,848,956.00	3.33%
8	幸福人寿保险股份有限公司—分红	67,344,721.00	2.24%
9	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—银保分红	54,000,000.00	1.80%
10	泰康人寿保险股份有限公司—万能—一个险万能	43,723,013.00	1.46%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	0.00%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
23,709	126,534.23	2,142,842,991.00	71.43%	857,157,009.00	28.57%

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户数。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险（集团）公司	496,754,277.00	16.56%
2	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	247,831,402.00	8.26%
3	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L-FH002 深	203,567,073.00	6.79%
4	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品—013C-CT001 深	188,241,873.00	6.27%
5	中国人寿保险股份有限公司	173,195,142.00	5.77%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	126,977,498.00	4.23%
7	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金—012G-ZY001 深	99,848,956.00	3.33%
8	幸福人寿保险股份有限公司—分红	67,344,721.00	2.24%
9	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—银保分红	54,000,000.00	1.80%
10	泰康人寿保险股份有限公司—万能—一个险万能	43,723,013.00	1.46%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	0.00%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 12 月 26 日）基金份额总额	3,000,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
报告期期末基金份额总额	3,000,000,000.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2014 年 12 月 16 日发布《大成基金管理有限公司关于景福证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，主要内容为：本次基金份额持有人大会审议了《关于景福证券投资基金转型相关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”），并由出具有效书面表决意见的基金份额持有人对本次会议议案进行表决，并最终通过了本次会议议案。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：

1、基金管理人于 2014 年 1 月 25 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第五届董事会第二十八次会议审议通过，王颢先生不再担任大成基金管理有限公司总经理，由董事长张树忠先生代任公司总经理。

2、基金管理人于 2014 年 11 月 28 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第五届董事会第三十九次会议审议通过，由罗登攀先生任公司总经理。

3、基金管理人于 2014 年 12 月 20 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更

的公告》，经大成基金管理有限公司第五届董事会第三十九次会议审议通过，由刘卓先生任公司董事长及法定代表人，张树忠先生不再担任公司董事长。

二、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

因中国农业银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

转型前，本基金将指数化投资与积极投资有机结合，充分利用指数化投资和积极投资不同的风险收益特征，使整个投资组合达到风险和收益较好的平衡，力求在降低风险的同时，实现基金资产的长期稳定增值。

转型后，本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度支付的审计费用为 14 万元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人、托管人及高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	95,256,670.51	34.48%	86,721.72	34.89%	-

长江证券	1	78,689,326.59	28.48%	69,632.11	28.01%	-
广发证券	1	65,039,638.86	23.54%	59,212.08	23.82%	-
招商证券	1	37,317,521.64	13.51%	33,022.87	13.28%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内增加交易单元：无。

本报告期内退租交易单元：无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
国泰君安	2	3,395,483,304.53	26.75%	3,066,750.69	26.99%	-
国信证券	1	2,483,546,317.19	19.57%	2,197,722.04	19.34%	-
长江证券	1	1,948,422,867.86	15.35%	1,724,179.08	15.18%	-
光大证券	1	1,147,564,167.28	9.04%	1,044,737.64	9.20%	-
海通证券	1	905,466,600.24	7.13%	824,335.67	7.26%	-
华泰证券	1	825,250,980.23	6.50%	730,273.77	6.43%	-
中信证券	1	635,333,905.77	5.01%	562,211.89	4.95%	-
广发证券	1	527,942,354.25	4.16%	480,636.92	4.23%	-
平安证券	1	390,686,928.62	3.08%	345,724.11	3.04%	-
招商证券	1	382,193,275.63	3.01%	338,203.07	2.98%	-
中投证券	1	50,711,588.93	0.40%	46,167.60	0.41%	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内增加交易单元：无。

本报告期内退租交易单元：英大证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

国泰君安	132,606,776.70	66.91%	-	-	-	-
广发证券	65,578,155.00	33.09%	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、基金管理人于 2015 年 1 月 13 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，刘彩晖女士不再担任公司副总经理。

2、基金管理人于 2015 年 1 月 22 日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，由肖剑先生、钟鸣远先生任公司副总经理。

大成基金管理有限公司
2015 年 3 月 28 日